

国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期:2025 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年03月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自2024年01月01日起至2024年12月31日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	14
§ 4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	20
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	20
§ 5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	20
§ 6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	21
§ 7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	24
7.3 净资产变动表	26
7.4 报表附注	27
§ 8 投资组合报告	59
8.1 期末基金资产组合情况	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	60
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	79
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	81
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	81
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	81

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	81
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	81
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	81
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	81
8.12 投资组合报告附注	81
§ 9 基金份额持有人信息.....	83
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	83
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	83
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	84
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	84
§ 10 开放式基金份额变动.....	84
§ 11 重大事件揭示	85
11.1 基金份额持有人大会决议	85
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	85
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	86
11.4 基金投资策略的改变	86
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	86
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	86
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	86
11.8 其他重大事件.....	86
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	89
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	89

12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
§ 13 备查文件目录	89
13.1 备查文件目录.....	89
13.2 存放地点	89
13.3 查阅方式.....	90

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金		
基金简称	国泰君安量化选股混合发起		
基金主代码	016466		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2022 年 08 月 18 日		
基金管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司		
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	933,195,587.71 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	国泰君安量化选股混合发起 A	国泰君安量化选股混合发起 C	国泰君安量化选股混合发起 D
下属分级基金的交易代码	016466	016467	018963
报告期末下属分级基金的份额总额	358,709,206.33 份	201,995,901.44 份	372,490,479.94 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	<p>本基金依据宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，重点关注包括 GDP 增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势，同时强调金融市场投资者行为分析，关注资本市场资金供求关系变化等因素，在深入分析基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度，形成资产配置方案。</p> <p>本基金的投资策略还包括股票投资策略、债券投资策略、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略。</p>
业绩比较基准	中证全指指数收益率*80%+中债综合全价指数收益率*20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	上海国泰君安证券资产管理有 限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公 司
信息披露负责 人	姓名	吕巍
	联系电话	021-38676022
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com
客户服务电话	95521	95580
传真	021-38871190	010-68858120
注册地址	上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室	北京市西城区金融大街 3 号
办公地址	上海市静安区新闻路 669 号博 华广场 22-23 层及 25 层	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码	200120	100808
法定代表人	陶耿	刘建军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名 称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理 人互联网网址	www.gtjazg.com
基金年度报告备置地点	上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合 伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢外经贸大厦 901-22 至 901-26
注册登记机构	上海国泰君安证券资产管理有限公 司	上海市静安区新闻路 669 号博华广 场 22-23 层及 25 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3. 1. 1 期 间 数	2024 年			2023 年			2022 年 08 月 18 日 (基金合同生效日) -2022 年 12 月 31 日		
	国泰君 安量化 选股混	国泰君 安量化 选股混	国泰君 安量化 选股混	国泰君安 量化选股 混合发起	国泰君 安量化 选股混	国泰君 安量化 选股混	国泰君 安量化 选股混	国泰君 安量化 选股混	国泰君 安量化 选股混

据和指标	合发起 A	合发起 C	合发起 D	A	合发起 C	合发起 D	合发起 A	合发起 C	安量化选股混合发起 D
本期已实现收益	- 40,579, 282.91	- 32,310, 117.91	- 1,405,6 04.18	- 49,107,52 0.72	- 42,276, 982.73	- 24,976, 346.14	- 163,37 0.41	- 84,663 .47	-
本期利润	- 26,170, 236.20	- 27,079, 859.35	- 25,441, 478.57	- 55,705,19 0.31	- 52,073, 956.82	- 23,517, 422.04	- 504,82 2.53	- 283,79 9.57	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0391	-0.0726	-0.0521	-0.1209	-0.1214	-0.0512	- 0.0500	- 0.0499	-
本期加权平均净值利润率	-4.03%	-7.54%	-5.32%	-11.51%	-11.58%	-4.94%	-5.12%	-5.12%	-

本期基金份额净值增长率	7.37%	6.94%	6.94%	8.33%	7.91%	-6.89%	-4.95%	-5.09%	-
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末			2023 年末			2022 年末		
期末可供分配利润	34,970,103.79	17,625,985.20	34,056,389.21	29,935,652.75	17,356,816.53	23,389,986.89	-506,763.54	-317,969.07	-
期末可供分配基金份额利润	0.0975	0.0873	0.0914	0.0297	0.0242	0.0281	-0.0495	-0.0509	-
期末基金	396,590,371.51	221,238,980.87	409,556,119.71	1,036,499,004.33	733,941,009.80	854,505,674.74	9,723,190.01	5,924,384.99	-

金 资 产 净 值									
期 末 基 金 份 额 净 值	1.1056	1.0953	1.0995	1.0297	1.0242	1.0281	0.9505	0.9491	-
3.1.3 累 计 期 末 指 标	2024 年末			2023 年末			2022 年末		
基 金 份 额 累 计 净 值 增 长 率	10.56%	9.53%	-0.43%	2.97%	2.42%	-6.89%	-4.95%	-5.09%	-

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰君安量化选股混合发起 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.44%	1.88%	1.38%	1.56%	3.06%	0.32%
过去六个月	19.36%	1.74%	14.80%	1.48%	4.56%	0.26%
过去一年	7.37%	1.68%	7.49%	1.28%	-0.12%	0.40%
自基金合同生效起至今	10.56%	1.30%	-6.36%	1.00%	16.92%	0.30%

国泰君安量化选股混合发起 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.33%	1.88%	1.38%	1.56%	2.95%	0.32%
过去六个月	19.12%	1.74%	14.80%	1.48%	4.32%	0.26%
过去一年	6.94%	1.68%	7.49%	1.28%	-0.55%	0.40%
自基金合同生效起至今	9.53%	1.30%	-6.36%	1.00%	15.89%	0.30%

国泰君安量化选股混合发起 D 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.34%	1.88%	1.38%	1.56%	2.96%	0.32%
过去六个月	19.11%	1.74%	14.80%	1.48%	4.31%	0.26%
过去一年	6.94%	1.68%	7.49%	1.28%	-0.55%	0.40%
自基金合同生效起至今	-0.43%	1.50%	-1.89%	1.14%	1.46%	0.36%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰君安量化选股混合发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年08月18日-2024年12月31日)



国泰君安量化选股混合发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年08月18日-2024年12月31日)

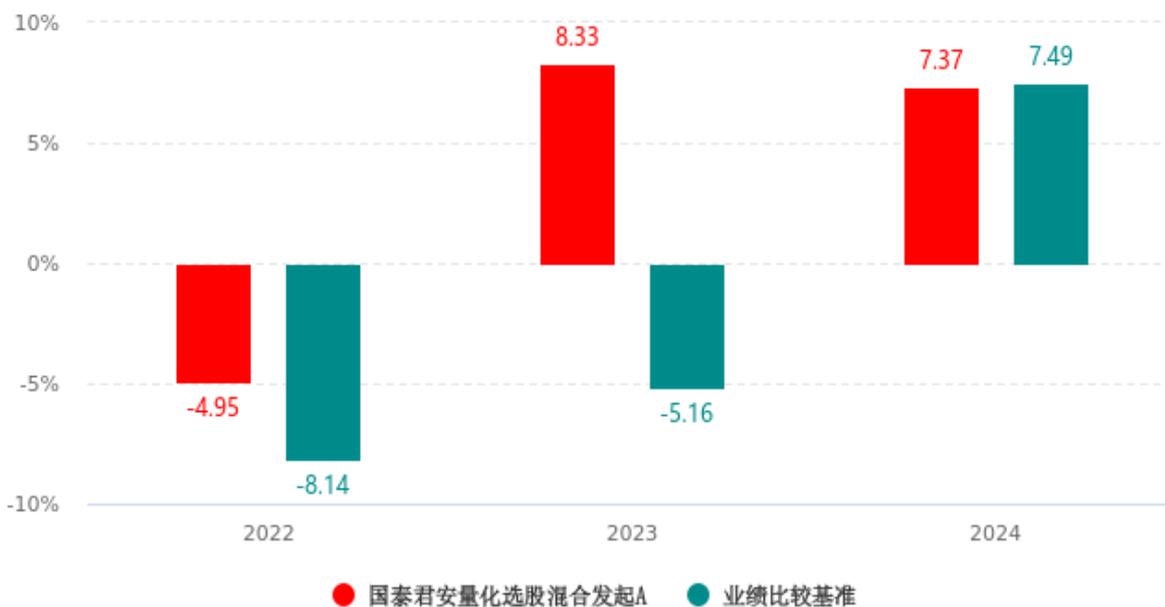


国泰君安量化选股混合发起D累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2023年08月07日-2024年12月31日)

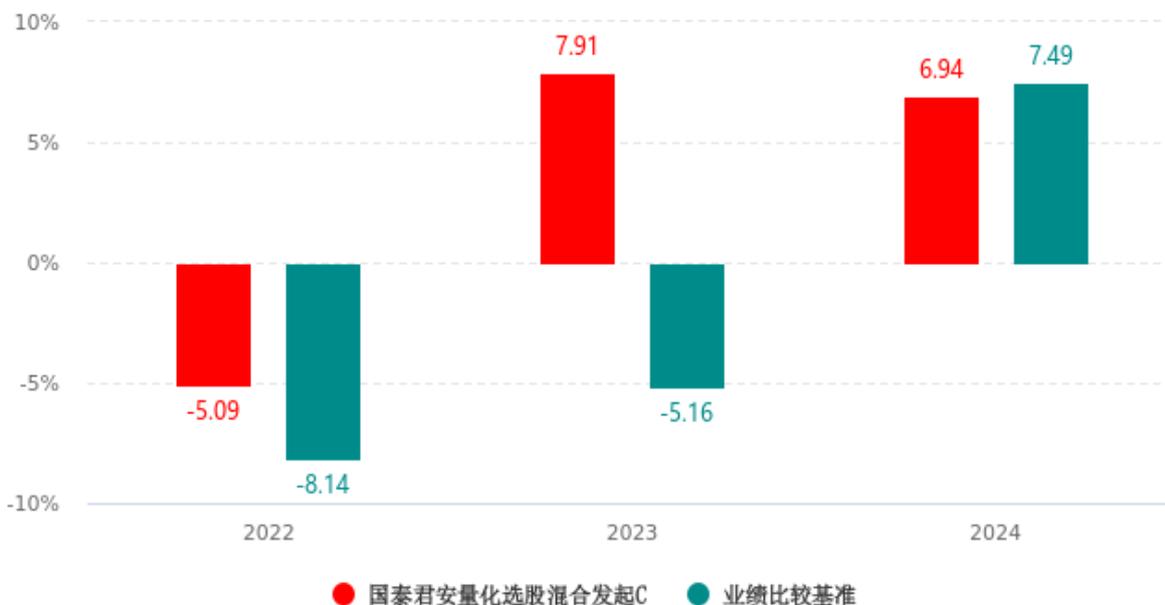


注：本基金于 2022 年 8 月 18 日成立，D 类份额于 2023 年 8 月 7 日首次申购确认，D 类份额当期的相关数据和指标按实际存续期（即 2023 年 8 月 7 日至 2024 年 12 月 31 日）计算。

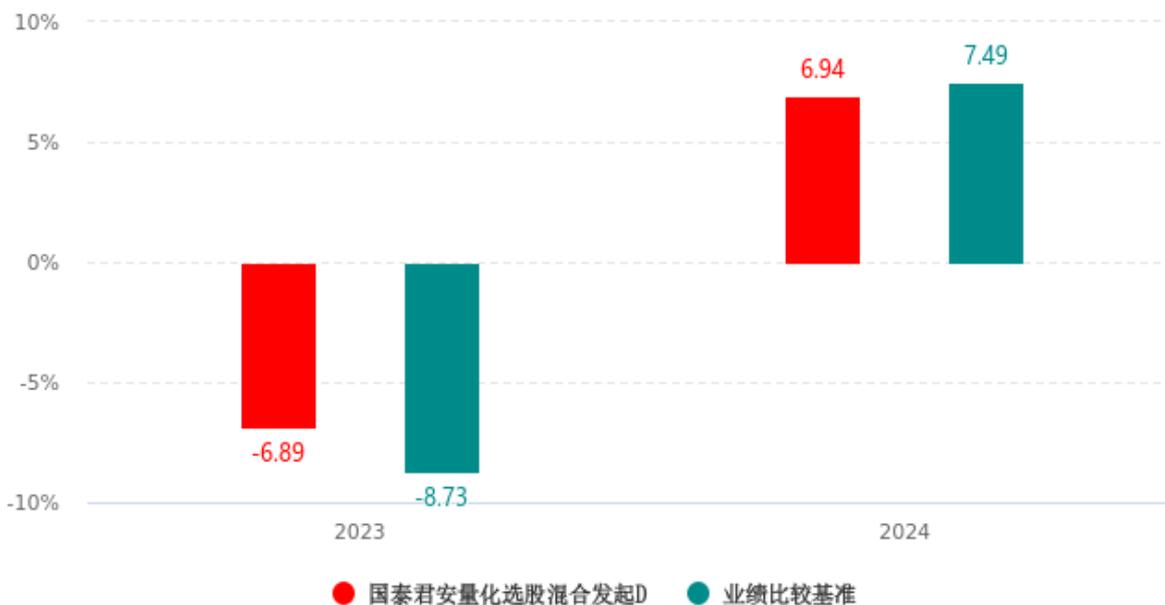
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为 2022 年 08 月 18 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



注：本基金合同生效日为 2022 年 08 月 18 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



注：本基金合同生效日为 2022 年 08 月 18 日，D 类份额于 2023 年 8 月 7 日首次申购确认，D 类份额首次申购确认当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海国泰君安证券资产管理有限公司正式成立于 2010 年 10 月 18 日，经中国证监会证监许可【2010】631 号文批准，是业内首批券商系资产管理公司。公司注册资本金 20 亿元，注册地上海。

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理国泰君安现金管家货币市场基金、国泰君安 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、国泰君安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金、国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金、国泰君安君得明混合型证券投资基金、国泰君安东久新经济产业园封闭式基础设施证券投资基金、国泰君安君得利短债债券型证券投资基金、国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、国泰君安 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安安弘六个月定期开放债券型证券投资基金、国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金等 57 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡崇海	国泰君安中证 500 指数增强基金经理，国泰君安中证 1000 指数增强基金经理，国泰君安量化选股混合发起基金经理，国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金经理，国泰君安沪深 300 指数增强发起基金经理，国泰君安中证 1000 优选股票发起基金经理，国泰君安稳债增利债券发起基金经理，国泰君安科创板量化选股股票发起基金经理，国泰君安红利量化选股混合基金经理，国泰君安中证 A500 指数增	2022-08-18	-	13 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士。曾任香港科技大学人工智能实验室访问学者，其后加盟方正证券研究所、国泰君安证券咨询部及研究所从事量化对冲模型的研发工作，2014 年加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，先后在量化投资部、权益与衍生品部担任高级投资经理，从事量化投资和策略研发工作，在 Alpha 量化策略以及基于机器学习的投资方面有独到且深入的研究。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。

	<p>强基金经理。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。</p>				
--	---	--	--	--	--

注：1、上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规、相关规定以及基金合同、招募说明书约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法违规行为及违反基金合同、招募说明书约定的行为，无侵害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《上海国泰君安证券资产管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所有的投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 8 次。本基金与本公司管理的其他组合在不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年 A 股市场经历“政策驱动、结构剧变”的深度调整与修复过程，全年呈现“双底反转、风格轮动”的 W 型走势。本年度前两个季度 A 股市场呈现“V 型探底→政策托底→分化加剧”的波动特征，核心矛盾体现为政策对冲与基本面压力的博弈：一季度流动性冲击后政策快速响应稳定市场，二季度政策红利边际递减，市场回归基本面定价逻辑。从九月底开始，政策组合拳（证券基金互换便利等）超预期出台，高 Beta 板块（非银、计算机）引领反弹，风格迅速从价值切换至成长，全年 A 股整体上经历“流动性冲击→政策托底→风格再平衡”过程，监管层通过打击财务造假、优化退市等改革重塑生态，为股市中长期健康发展奠定扎实的基础。从主要宽基指数来看，大盘价值类指数表现较好，例如沪深 300 指数（涨幅 14.68%），中证红利（涨幅 12.31%），而小盘成长类指数除科创 50 外均表现较差，例如中证 1000（涨幅 1.20%），科创 100（跌幅 8.56%）。展望 2025 年，A 股有望在“政策护航与业绩修复”双轮驱动下开启慢牛征程。政策层面，互换便利与专项再贷款等央行创新货币工具进入落地阶段，叠加二十届三中全会提出的科技体制改革以及聚焦科创板高质量发展的“科创板八条”等产业政策深化，将强化流动性支持与成长股投资逻辑，市场驱动逻辑料从估值修复转向盈利验证，全 A 净利润增速有望企稳回升。结构上，上半年流动性宽松或催化小盘科技股行情，下半年随经济数据验证，顺周期板块或接力。全年看，科技与高端制造的高弹性、消费板块的修复潜力及政策受益方向或成为超额收益来源，市场或沿“震荡螺旋上升”路径演绎。

从主要风险因子的走势来看，市值因子在年初表现强势，之后趋于稳定，这与年初大跌时大盘股占优，后走向小盘的市场风格相符。动量因子在前半年走强，后半年趋于平稳。全年的风格轮动依然明显，红利和微盘轮番“搭台唱戏”，哑铃型策略占优。Alpha 表现方面，上半年基本面因子表现突出，分红、盈利因子稳步获利，红利低波风格一度成为市场追逐的热点。但进入下半年后基本面因子有所回落，高频量价类因子在这一阶段迎来业绩赶超。鉴于今年市场环境的复杂性，我们更加重视提升业绩稳定性，根据市场的演化过程不断引入新的因子和改良原有的模型，并强化选股模型对不同风格的适应能力，在保持稳重求胜的风格下追求更好的超额收益率。展望未来，随着经济进一步复苏以及政策进一步发力，资本市场信心和活跃度有望逐步恢复，我们认为基本面和量价模型会有较好的发挥空间，同时我们也将合理进行模型配置。

行业方面表现分化，政策与产业趋势主导结构性机会。大金融板块全年领涨，银行与非银金融受益于低估值修复及政策利好，涨幅超 30%；通信行业延续 TMT 板块强势，商业化落地加速推动估值提升。家电、汽车等可选消费板块凭借政策扶持与消费升级需求释放，表现居前。相比之下，医药生物、农林牧渔及美容护理等板块受需求疲软拖累，收益率排名靠后。2025 年，科技板块中 AI 基础设施建设、半导体周期上行及软硬科技产业化进程或成为主线，家电、汽车及电子行业亦存在业绩与估值双击潜力；消费板块经历连续调整后，困境反转机会值得关注。

以分散化投资为主的量化投资在今年超大盘股引领的防御性行情下，阶段性面临一定的挑战，

也本没有一种投资方法论可以通吃所有风格的行情，但是量化投资从投资理念和投资逻辑来讲并未发生本质性改变，以博取 Alpha 为主要目的的量化选股型产品在当前市场点位仍具有很高的性价比。尽管市场风格和行业走势会发生变化，但我们仍将坚持一贯的投资理念和投资组合管理体系。在本基金中，我们通过挖掘有投资逻辑的 Alpha 因子，不断改进底层量化模型以及定期监控策略的表现等方式来增强策略表现。我们一直坚守一贯的投资体系和理念，并尽可能以此来稳定投资者对我们超额收益率的预期。在量化增强层面，我们将结合财务数据为基础的基本面信号和量价信号，通过机器学习模型来有效选择因子，在全市场选股的基础上，通过投资组合管理的方式在控制投资组合整体风险的同时最大化 Alpha 能力的输出。由于基本面量化和量价在信号层面较低的相关性，我们相信能够在兼顾两者的情况下追求稳健的 Alpha。作为全市场选股的量化基金，相比于通过控制仓位来做择时操作，我们更倾向于通过较稳定的仓位运行来最大程度的兑现我们稳定的 Alpha 能力。我们的投资策略是通过积少成多、以概率取胜的方式增厚投资收益，因此更需要投资者长期持有。我们认为当前市场整体估值依然处于历史低估阶段，未来上涨的空间依然大于下跌的空间，我们将努力通过科学的手段强化量化模型的超额收益率水平，以此不断为客户增厚投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安量化选股混合发起 A 基金份额净值为 1.1056 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 7.37%，同期业绩比较基准收益率为 7.49%；截至报告期末国泰君安量化选股混合发起 C 基金份额净值为 1.0953 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 6.94%，同期业绩比较基准收益率为 7.49%；截至报告期末国泰君安量化选股混合发起 D 基金份额净值为 1.0995 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 6.94%，同期业绩比较基准收益率为 7.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年 A 股市场呈现显著的波动性特征，全年经历了流动性冲击、政策驱动反弹及风格切换等多重考验。年初市场因雪球敲入、两融与 DMA 爆仓等风险事件引发流动性危机，中小盘指数承压；春节后政策托底力度加大，ETF 资金加速流入带动市场超跌反弹。9 月政策全面发力（如“并购六条”、市值管理政策），推动市场风险偏好大幅提升，科创板领头带领市场强势反弹。展望 2025 年，市场预计在政策深化与资金面改善的双重驱动下延续结构性行情。政策层面，“1+N”政策体系将推动资本市场高质量发展，并购重组政策引导资源向新质生产力领域集中，科技、高端制造等领域有望迎来整合潮；财政与货币政策协同发力，特别国债及专项债规模扩大，进一步释放流动性。资金面方面，险资、ETF 及外资构成三大增量来源，市场风险偏好回暖，资金供给端的规模有望较 2024 年明显改善。从量化模型的 Alpha 角度来看，市场交易量的提升，风险偏好的提高有利于 Alpha 的发挥。另一方面在投研过程中，我们也逐步强化另类因子的挖掘、异质化思维建模、提升实盘模型的逻辑性、加强全方位的综合 Alpha 解决能力以及策略配置能力等，从而巩固通过量化的投资方法在各种不同的风格下博取超额收益的能力。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合规运作角度出发，在合规文化建设、制度体系建设、合规审查及检查、反洗钱、员工执业行为规范等角度开展工作，不断深化员工的合规意识，推动公司合规文化和内部风险控制机制的完善和优化。

内部监察工作重点包括以下几个方面：

1、合规文化建设。管理人通过内外部合规培训、合规考试、法规解读、法律法规库维护更新、监管会议精神传达等多种形式推动公司合规文化建设，不断提高全体员工合规意识，为公司业务健康发展提供良好的文化土壤。

2、制度体系建设和完善。管理人根据法律法规变化，结合行业新动态，围绕新业务需要，不断优化和健全公司制度体系，并注重相关制度体系的落实和执行。通过制度体系的建设和完善，不断提升了业务管理流程的健全性、规范性、精细化和可操作性，为公司业务规范运营和合规管理进一步夯实了制度基础。

3、合规审查和检查。根据法律法规、监管要求和公司制度规定，做好对公司新业务、新产品、新投资品种及其他创新业务的法律合规及风险控制支持，定期对产品销售、投资、研究及交易等相关业务活动的日常合规性进行检查，查漏补缺。合规检查工作促进了内部控制管理的完善，防范了合规风险的进一步发生。

4、员工执业与投资行为管理。根据法律法规和公司制度要求，管理人不断加强员工执业行为管理。管理人要求新员工入职时需提供和完善个人信息并完成相关投资的申报工作，对投资、交易人员的通讯工具实行交易时间段集中管理，并对监控摄像、电子邮件、电话录音和即时通讯工具聊天记录定期进行合规检查。通过一系列常态化的员工执业和投资行为管理，促进员工执业和投资行为持续符合监管要求。

5、反洗钱合规管理。本报告期内，管理人持续加强反洗钱合规管理，制定反洗钱工作方案，并在年度内推进落实。持续做好日常可疑交易监控排查、客户风险等级划分、修订反洗钱内部控制管理制度、跟进反洗钱系统改造、完成各类反洗钱工作报告、反洗钱金融机构分类评级自评工作等。

管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部合规风控工作的科学性和有效性，努力防范和控制各类风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	容诚审字[2025]200Z1988 号
--------	----------------------

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金（以下简称“国泰君安量化选股混合发起基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了国泰君安量化选股混合发起基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国泰君安量化选股混合发起基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>国泰君安量化选股混合发起基金的基金管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估国泰君安量化选股混合发起基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算国泰君安量化选股混合发起基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督国泰君安量化选股混合发起基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则</p>

	<p>执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对国泰君安量化选股混合发起基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国泰君安量化选股混合发起基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	张振波 徐翹楚
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢外经贸大厦 901-22 至 901-26
审计报告日期	2025-03-25

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	112,252,222.74	178,682,778.20
结算备付金		2,938,970.17	16,193,213.38
存出保证金		1,925,860.80	-
交易性金融资产	7.4.7.2	936,832,140.23	2,444,062,227.49
其中：股票投资		936,832,140.23	2,444,062,227.49
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,444,248.24	16,823,492.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		1,055,393,442.18	2,655,761,711.28
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		26,424,421.21	27,588,252.46
应付管理人报酬		1,005,065.55	2,194,652.52
应付托管费		150,759.85	329,197.86
应付销售服务费		256,074.47	536,577.83
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	171,649.01	167,341.74
负债合计		28,007,970.09	30,816,022.41
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	933,195,587.71	2,554,263,232.70
未分配利润	7.4.7.8	94,189,884.38	70,682,456.17
净资产合计		1,027,385,472.09	2,624,945,688.87
负债和净资产总计		1,055,393,442.18	2,655,761,711.28

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 933,195,587.71 份。其中国泰君安量化选股混合发起 A 基金份额净值 1.1056 元，基金份额总额 358,709,206.33 份；国泰君安量化选股混合发起 C 基金份额净值 1.0953 元，基金份额总额 201,995,901.44 份；国泰君安量化选股混合发起 D 基金份额净值 1.0995 元，基金份额总额 372,490,479.94 份。

7.2 利润表

会计主体：国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-58,060,347.65	-115,854,592.61
1. 利息收入		657,472.79	453,129.51
其中：存款利息收入	7.4.7.9	657,472.79	453,129.51
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-59,223,049.55	-106,240,830.35
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-78,700,657.53	-108,892,116.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.11	-5,263,520.86	-5,390,467.52
股利收益	7.4.7.12	24,741,128.84	8,041,753.92
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	-4,396,569.12	-14,935,719.58
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	4,901,798.23	4,868,827.81
减：二、营业总支出		20,631,226.47	15,441,976.56
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	14,881,071.09	11,082,010.73
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,232,160.78	1,662,301.66
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	3,347,994.60	2,532,264.17

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.15	170,000.00	165,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-78,691,574.12	-131,296,569.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-78,691,574.12	-131,296,569.17
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-78,691,574.12	-131,296,569.17

7.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,554,263,232.70	70,682,456.17	2,624,945,688.87
二、本期期初净资产	2,554,263,232.70	70,682,456.17	2,624,945,688.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	23,507,428.21	-
	1,621,067,644.99		1,597,560,216.78
（一）、综合收益总额	-	-78,691,574.12	-78,691,574.12
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	102,199,002.33	-
	1,621,067,644.99		1,518,868,642.66
其中：1. 基金申购款	1,260,255,519.23	-1,093,873.24	1,259,161,645.99
2. 基金赎回款	-	103,292,875.57	-
	2,881,323,164.22		2,778,030,288.65
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净	-	0.00	-

资产减少以“-”号填列)			
四、本期期末净资产	933,195,587.71	94,189,884.38	1,027,385,472.09
项 目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	16,472,307.61	-824,732.61	15,647,575.00
二、本期期初净资产	16,472,307.61	-824,732.61	15,647,575.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,537,790,925.09	71,507,188.78	2,609,298,113.87
（一）、综合收益总额	-	-131,296,569.17	-131,296,569.17
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	2,537,790,925.09	202,803,757.95	2,740,594,683.04
其中：1. 基金申购款	3,603,754,601.32	240,780,847.62	3,844,535,448.94
2. 基金赎回款	-	-37,977,089.67	-
	1,065,963,676.23		1,103,940,765.90
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	2,554,263,232.70	70,682,456.17	2,624,945,688.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

陶耿	陶耿	王红莲
-----	-----	-----
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]1607号《关于准予国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金注册的批复》注册,由上海国泰君安证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币15,019,990.10元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第0716号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》于2022年8月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为15,019,990.10份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为15,019,000.00份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《关于国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金增加 D 类基金份额并修改法律文件的公告》，本基金自 2023 年 8 月 1 日起在原有 A 类基金份额和 C 类基金份额的基础上增加 D 类份额，并对本基金的基金合同作相应修改。本基金增加 D 类基金份额后，三类基金份额分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。投资者申购时可以自主选择与 A 类基金份额、C 类基金份额或 D 类基金份额相对应的基金代码进行申购。

根据《国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取申购费用的基金份额，称为 D 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，本基金可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票(含存托凭证)资产占基金资产的 60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率×80%+中债综合全价指数收益率×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,确认为应计利息,包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息,以发生违约的风险为权重,计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额,确认预期信用损失。

于每个资产负债表日,本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的,处于第一阶段,本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备;金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的,处于第二阶段,本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备;金融工具自初始确认后已经发生信用减值的,处于第三阶段,本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中

心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	68,412,362.94	48,750,967.45
等于：本金	68,396,257.42	48,734,777.63
加：应计利息	16,105.52	16,189.82
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	43,839,859.80	129,931,810.75
等于：本金	43,838,915.01	129,924,012.99
加：应计利息	944.79	7,797.76
减：坏账准备	-	-
合计	112,252,222.74	178,682,778.20

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		956,513,995.44	-	936,832,140.23	-
					19,681,855.21
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		956,513,995.44	-	936,832,140.23	-
					19,681,855.21
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,459,538,535.29	-	2,444,062,227.49	-
					15,476,307.80
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,459,538,535.29	-	2,444,062,227.49	-
					15,476,307.80

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	16,239,861.71	-	-	-
--股指期货	16,239,861.7	-	-	-

	1			
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	16,239,861.71	-	-	-
	1			
	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
项目	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2501	IC2501	6	6,863,520.00	30,600.00
IC2503	IC2503	4	4,540,320.00	-68,256.00
IM2501	IM2501	1	1,191,160.00	5,480.00
IM2506	IM2506	3	3,453,840.00	-158,845.71
合计				-191,021.71
减：可抵销期货暂收款				-191,021.71
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,649.01	2,341.74
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提审计费	50,000.00	45,000.00
合计	171,649.01	167,341.74

7.4.7.7 实收基金

国泰君安量化选股混合发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,006,563,351.58	1,006,563,351.58
本期申购	485,517,051.93	485,517,051.93
本期赎回（以“-”号填列）	-1,133,371,197.18	-1,133,371,197.18
本期末	358,709,206.33	358,709,206.33

国泰君安量化选股混合发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	716,584,193.27	716,584,193.27
本期申购	139,543,611.99	139,543,611.99
本期赎回（以“-”号填列）	-654,131,903.82	-654,131,903.82

本期末	201,995,901.44	201,995,901.44
-----	----------------	----------------

国泰君安量化选股混合发起 D

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	831,115,687.85	831,115,687.85
本期申购	635,194,855.31	635,194,855.31
本期赎回（以“-”号填列）	-1,093,820,063.22	-1,093,820,063.22
本期末	372,490,479.94	372,490,479.94

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

国泰君安量化选股混合发起 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	54,224,501.26	-24,288,848.51	29,935,652.75
本期期初	54,224,501.26	-24,288,848.51	29,935,652.75
本期利润	-40,579,282.91	14,409,046.71	-26,170,236.20
本期基金份额交易产生的变动数	21,324,885.44	12,790,863.19	34,115,748.63
其中：基金申购款	-12,076,012.64	3,633,102.29	-8,442,910.35
基金赎回款	33,400,898.08	9,157,760.90	42,558,658.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,970,103.79	2,911,061.39	37,881,165.18

国泰君安量化选股混合发起 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34,622,777.33	-17,265,960.80	17,356,816.53

本期期初	34,622,777.33	-17,265,960.80	17,356,816.53
本期利润	-32,310,117.91	5,230,258.56	-27,079,859.35
本期基金份额交易产生的变动数	15,313,325.78	13,652,796.47	28,966,122.25
其中：基金申购款	-1,753,097.04	5,721,024.62	3,967,927.58
基金赎回款	17,066,422.82	7,931,771.85	24,998,194.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,625,985.20	1,617,094.23	19,243,079.43

国泰君安量化选股混合发起 D

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	43,456,244.29	-20,066,257.40	23,389,986.89
本期期初	43,456,244.29	-20,066,257.40	23,389,986.89
本期利润	-1,405,604.18	-24,035,874.39	-25,441,478.57
本期基金份额交易产生的变动数	-7,994,250.90	47,111,382.35	39,117,131.45
其中：基金申购款	-15,908,938.78	19,290,048.31	3,381,109.53
基金赎回款	7,914,687.88	27,821,334.04	35,736,021.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,056,389.21	3,009,250.56	37,065,639.77

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	438,172.60	205,560.39
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	93,140.03	163,888.22
结算备付金利息收入	126,160.16	83,680.90
其他	-	-
合计	657,472.79	453,129.51

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	21,508,079,057.66	22,018,073,925.87
减：卖出股票成本总额	21,570,370,579.90	22,105,996,995.40
减：交易费用	16,409,135.29	20,969,047.22
买卖股票差价收入	-78,700,657.53	-108,892,116.75

7.4.7.11 衍生工具收益

7.4.7.11.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-5,169,678.29	-5,155,300.00
减：交易费用	93,842.57	235,167.52
合计	-5,263,520.86	-5,390,467.52

7.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	24,741,128.84	8,041,753.92
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	24,741,128.84	8,041,753.92

7.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-4,205,547.41	-14,935,719.58
——股票投资	-4,205,547.41	-14,935,719.58
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-191,021.71	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-191,021.71	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变 动产生的预估增值税	-	-
合计	-4,396,569.12	-14,935,719.58

7.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	4,901,798.23	4,868,827.81
合计	4,901,798.23	4,868,827.81

7.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	45,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	-	400.00
合计	170,000.00	165,400.00

7.4.7.16 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海国泰君安证券资产管理有限公司(以下简称“国泰君安资管”)	基金管理人
中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称“中国邮政储蓄银行”)	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君安证券”)	基金管理人的股东、代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日
-------	--------------------------------	--------------------------

	月 31 日		至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券	41,572,175,199.85	100.00%	46,560,639,527.76	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金报告期及上年度可比期间未有通过关联方单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券	2,988,796.72	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券	3,319,055.58	100.00%	0.00	0.00%

注：1. 上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席位租用协议进行约定，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结算风险基金后的净额列示。

2. 该类席位租用协议服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，针对被动股票型基金佣金协议的服务范围不包括研究服务、流动性服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,881,071.09	11,082,010.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,217,231.83	3,288,472.98
应支付基金管理人的净管理费	10,663,839.26	7,793,537.75

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年实际天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,232,160.78	1,662,301.66

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年实际天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	国泰君安量化 选股混合发起 A	国泰君安量化 选股混合发起 C	国泰君安量化 选股混合发起 D	合计
国泰君安证券	-	548,235.71	-	548,235.71
国泰君安资管	-	81,006.31	1,373,195.14	1,454,201.45
合计	-	629,242.02	1,373,195.14	2,002,437.16

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	国泰君安量化选股混合发起 A	国泰君安量化选股混合发起 C	国泰君安量化选股混合发起 D	合计
国泰君安证券	-	412,067.42	0.00	412,067.42
国泰君安资管	-	268,548.97	438,257.98	706,806.95
合计	-	680,616.39	438,257.98	1,118,874.37

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费，C/D 类份额的销售服务费年费率为 0.40%，销售服务费按前一日 C/D 类份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C/D 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C/D 类份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国泰君安量化选股混合发起 A

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2022 年 08 月 18 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,009,000.00	10,009,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-

报告期末持有的基金份额	10,009,000.00	10,009,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.79%	0.99%

国泰君安量化选股混合发起 C

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2022 年 08 月 18 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	5,010,000.00	5,010,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,010,000.00	5,010,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.48%	0.70%

国泰君安量化选股混合发起 D

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2022 年 08 月 18 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	35,071,750.28	-
报告期间申购/买入总份额	-	35,071,750.28
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	35,071,750.28	-
报告期末持有的基金份额	0.00	35,071,750.28
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	4.22%

注：1. 基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。2. 报告期末持有的本基金份额占基金分类份额比例，比例的分母采用各自类别的份额计算。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

国泰君安量化选股混合发起 D

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基	持有的基金份额	持有的基	持有的基金份额

	金份额	占基金总份额的比例	金份额	占基金总份额的比例
中国邮政储蓄银行	100,030.01	0.03%	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行，本基金上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行	68,412,362.94	438,172.60	48,750,967.45	205,560.39
国泰君安证券	43,839,859.80	93,140.03	129,931,810.75	163,888.22

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金的其他存款由基金结算机构国泰君安证券保管，按协议约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国泰君安证券	301456	盘古智能	网下询价	4,061.00	154,155.56

注：本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须做说明的其他关联方交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301626	苏州天脉	2024 年 10 月 17 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
688615	合合信息	2024 年 09 月 19 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	55.18	165.78	289	15,947.02	47,910.42	-
301611	珂玛科技	2024 年 08 月 07 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
688449	联芸科技	2024 年 11 月 20 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-
688605	先锋精科	2024 年 12 月 04 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688708	佳驰科技	2024 年 11 月 27 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-
688726	拉普拉斯	2024 年 10 月 22 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-
301551	无线传媒	2024 年 09 月 19 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-

603072	天和磁材	2024年12月24日	7个交易日	新股未上市	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	1-6个月(含)	主板打新限售	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
688750	金天钛业	2024年11月12日	1-6个月(含)	科创板打新限售	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-
301522	上大股份	2024年10月09日	1-6个月(含)	创业板打新限售	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
301631	壹连科技	2024年11月12日	1-6个月(含)	创业板打新限售	72.99	101.96	153	11,167.47	15,599.88	-
301622	英思特	2024年11月26日	1-6个月(含)	创业板打新限售	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301608	博实结	2024年07月25日	1-6个月(含)	创业板打新限售	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301613	新铝时代	2024年10月18日	1-6个月(含)	创业板打新限售	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-
301586	佳力奇	2024年08月21日	1-6个月(含)	创业板打新限售	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
688710	益诺思	2024年08月27日	1-6个月(含)	科创板打新限售	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
301617	博苑股份	2024年12月03日	1-6个月(含)	创业板打新限售	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-

301603	乔锋智能	2024年07月03日	1-6个月(含)	创业板打新限售	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301585	蓝宇股份	2024年12月10日	1-6个月(含)	创业板打新限售	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
001279	强邦新材	2024年09月27日	1-6个月(含)	股票流通受限	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
603207	小方制药	2024年08月19日	1-6个月(含)	股票流通受限	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603310	巍华新材	2024年08月07日	1-6个月(含)	股票流通受限	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603091	众鑫股份	2024年09月10日	1-6个月(含)	股票流通受限	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603350	安乃达	2024年06月26日	1-6个月(含)	股票流通受限	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603205	健尔康	2024年10月29日	1-6个月(含)	股票流通受限	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-

注: 1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了由董事会（含内部控制委员会）、经营管理层（含风险控制委员会、首席风险官）、风险管理部门，以及业务部门构成的四级风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金的托管行中国邮政储蓄银行股份有限公司，其他银行存款为国泰君安证券券商保证金，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2023 年 12 月 31 日：本基金未持有信用类债券）。”

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2024 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持证券均在证券交易所交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金、结算备付金。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年12 月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	112,252,222.74	-	-	-	112,252,222.74
结算备付金	2,938,970.17	-	-	-	2,938,970.17
存出保证金	1,925,860.80	-	-	-	1,925,860.80
交易性金融资产	-	-	-	936,832,140.23	936,832,140.23
应收申购款	-	-	-	1,444,248.24	1,444,248.24
资产总计	117,117,053.71	-	-	938,276,388.47	1,055,393,442.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	26,424,421.21	26,424,421.21
应付管理人报酬	-	-	-	1,005,065.55	1,005,065.55
应付托管费	-	-	-	150,759.85	150,759.85
应付销售服务费	-	-	-	256,074.47	256,074.47
其他负债	-	-	-	171,649.01	171,649.01
负债总计	-	-	-	28,007,970.09	28,007,970.09
利率敏感度缺口	117,117,053.71	-	-	910,268,418.38	1,027,385,472.09
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2023 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	178,682,778.20	-	-	-	178,682,778.20
结算备付金	16,193,213.38	-	-	-	16,193,213.38
交易性金融资产	-	-	-	2,444,062,227.49	2,444,062,227.49
应收申购款	-	-	-	16,823,492.21	16,823,492.21
资产总计	194,875,991.58	-	-	2,460,885,719.70	2,655,761,711.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	27,588,252.46	27,588,252.46
应付管理人报酬	-	-	-	2,194,652.52	2,194,652.52
应付托管费	-	-	-	329,197.86	329,197.86
应付销售服务费	-	-	-	536,577.83	536,577.83
其他负债	-	-	-	167,341.74	167,341.74
负债总计	-	-	-	30,816,022.41	30,816,022.41
利率敏感度缺口	194,875,991.58	-	-	2,430,069,697.29	2,624,945,688.87

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日或行权日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例 0.00% (2023 年 12 月 31 日: 0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2023 年 12 月 31 日: 同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	936,832,140.23	91.19	2,444,062,227.49	93.11
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	936,832,140.23	91.19	2,444,062,227.49	93.11

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 7.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	65,497,176.62	161,363,203.06
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-65,497,176.62	-161,363,203.06

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	936,290,837.20	2,442,669,456.36
第二层次	27,736.50	898,742.02
第三层次	513,566.53	494,029.11
合计	936,832,140.23	2,444,062,227.49

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	494,029.11	494,029.11
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,035,453.54	1,035,453.54
转出第三层次	-	1,311,602.68	1,311,602.68
当期利得或损失总额	-	295,686.56	295,686.56
其中：计入损益的利得或损失	-	295,686.56	295,686.56
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

失			
期末余额	-	513,566.53	513,566.53
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	306,390.29	306,390.29
项目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	0.00	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	621,978.55	621,978.55
转出第三层次	-	155,432.80	155,432.80
当期利得或损失总额	-	27,483.36	27,483.36
其中：计入损益的利得或损失	-	27,483.36	27,483.36
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	494,029.11	494,029.11
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	35,711.56	35,711.56

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期	513,566.53	亚式期权模型	预期年化波动率	34.23%-574.44%	负相关

的股票投资					
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	494,029.11	亚式期权模型	预期年化波动率	14.62%~217.75%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	936,832,140.23	88.77
	其中：股票	936,832,140.23	88.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	115,191,192.91	10.91
8	其他各项资产	3,370,109.04	0.32
9	合计	1,055,393,442.18	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 0.00 元，占期末净资产的比例为 0.00%；通过转融通证券出借业务的证券公允价值为 0.00 元，占资产净资产的比例为 0.00%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,194,795.63	0.12
B	采矿业	54,215,866.76	5.28
C	制造业	537,849,085.47	52.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,553,868.20	2.97
E	建筑业	18,841,308.60	1.83
F	批发和零售业	21,514,513.00	2.09
G	交通运输、仓储和邮政业	35,666,442.00	3.47
H	住宿和餐饮业	130,386.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,868,899.97	6.90
J	金融业	124,172,281.78	12.09
K	房地产业	4,945,892.00	0.48
L	租赁和商务服务业	8,454,225.00	0.82
M	科学研究和技术服务业	13,024,884.35	1.27
N	水利、环境和公共设施管理业	5,833,174.47	0.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	385,588.00	0.04
Q	卫生和社会工作	5,241,700.00	0.51
R	文化、体育和娱乐业	3,914,215.00	0.38
S	综合	25,014.00	0.00
	合计	936,832,140.23	91.19

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值 （元）	占基金资产净值比 例（%）
1	300750	宁德时代	68,700	18,274,200.00	1.78
2	601857	中国石油	1,143,100	10,219,314.00	0.99
3	601318	中国平安	193,700	10,198,305.00	0.99
4	601818	光大银行	2,432,900	9,415,323.00	0.92
5	601766	中国中车	1,109,100	9,294,258.00	0.90
6	600887	伊利股份	281,200	8,486,616.00	0.83
7	688981	中芯国际	88,302	8,355,135.24	0.81
8	600519	贵州茅台	5,400	8,229,600.00	0.80
9	601288	农业银行	1,500,100	8,010,534.00	0.78
10	601988	中国银行	1,434,400	7,903,544.00	0.77
11	000617	中油资本	1,119,700	7,714,733.00	0.75
12	601919	中远海控	486,600	7,542,300.00	0.73
13	000895	双汇发展	285,300	7,406,388.00	0.72
14	300014	亿纬锂能	156,900	7,333,506.00	0.71
15	600016	民生银行	1,762,106	7,277,497.78	0.71
16	600941	中国移动	60,700	7,172,312.00	0.70
17	002249	大洋电机	1,220,200	7,162,574.00	0.70
18	600295	鄂尔多斯	727,670	7,102,059.20	0.69
19	603986	兆易创新	65,200	6,963,360.00	0.68
20	601169	北京银行	1,126,800	6,929,820.00	0.67
21	601899	紫金矿业	455,473	6,886,751.76	0.67
22	600188	兖矿能源	485,400	6,878,118.00	0.67
23	002475	立讯精密	167,600	6,831,376.00	0.66
24	600742	一汽富维	760,800	6,733,080.00	0.66
25	600015	华夏银行	831,600	6,661,116.00	0.65
26	000725	京东方 A	1,499,100	6,581,049.00	0.64
27	300433	蓝思科技	298,900	6,545,910.00	0.64
28	002414	高德红外	880,466	6,541,862.38	0.64
29	000937	冀中能源	1,024,200	6,472,944.00	0.63

30	000021	深科技	325,400	6,202,124.00	0.60
31	600282	南钢股份	1,301,000	6,101,690.00	0.59
32	000333	美的集团	81,100	6,100,342.00	0.59
33	002273	水晶光电	269,300	5,983,846.00	0.58
34	601006	大秦铁路	880,000	5,966,400.00	0.58
35	603259	药明康德	108,200	5,955,328.00	0.58
36	601633	长城汽车	218,683	5,757,923.39	0.56
37	600582	天地科技	923,900	5,709,702.00	0.56
38	601187	厦门银行	1,001,200	5,646,768.00	0.55
39	000001	平安银行	478,000	5,592,600.00	0.54
40	601997	贵阳银行	909,600	5,457,600.00	0.53
41	688041	海光信息	36,387	5,450,408.73	0.53
42	688469	芯联集成	1,042,734	5,349,225.42	0.52
43	601088	中国神华	122,000	5,304,560.00	0.52
44	300015	爱尔眼科	395,600	5,241,700.00	0.51
45	601399	国机重装	1,701,300	5,240,004.00	0.51
46	601107	四川成渝	1,000,700	5,233,661.00	0.51
47	601398	工商银行	751,700	5,201,764.00	0.51
48	600267	海正药业	623,100	5,171,730.00	0.50
49	000166	申万宏源	965,200	5,163,820.00	0.50
50	002396	星网锐捷	271,000	5,146,290.00	0.50
51	600050	中国联通	965,600	5,127,336.00	0.50
52	600517	国网英大	928,700	5,117,137.00	0.50
53	000063	中兴通讯	124,400	5,025,760.00	0.49
54	603501	韦尔股份	47,600	4,969,916.00	0.48
55	600795	国电电力	1,079,000	4,941,820.00	0.48
56	300079	数码视讯	894,475	4,839,109.75	0.47
57	600713	南京医药	962,000	4,771,520.00	0.46
58	300124	汇川技术	78,800	4,616,104.00	0.45
59	600096	云天化	196,400	4,379,720.00	0.43
60	601225	陕西煤业	187,400	4,358,924.00	0.42
61	600036	招商银行	109,200	4,291,560.00	0.42
62	600210	紫江企业	634,400	4,193,384.00	0.41
63	002916	深南电路	32,809	4,101,125.00	0.40
64	000977	浪潮信息	78,500	4,072,580.00	0.40
65	300502	新易盛	34,800	4,022,184.00	0.39
66	002027	分众传媒	569,200	4,001,476.00	0.39
67	688158	优刻得	283,514	3,963,525.72	0.39
68	300274	阳光电源	51,600	3,809,628.00	0.37
69	000517	荣安地产	1,691,000	3,770,930.00	0.37
70	600170	上海建工	1,411,700	3,741,005.00	0.36
71	601096	宏盛华源	856,800	3,727,080.00	0.36
72	300628	亿联网络	96,000	3,705,600.00	0.36

73	002489	浙江永强	1,139,300	3,691,332.00	0.36
74	603288	海天味业	80,000	3,672,000.00	0.36
75	002267	陕天然气	424,600	3,587,870.00	0.35
76	600578	京能电力	1,011,800	3,561,536.00	0.35
77	601866	中远海发	1,328,600	3,467,646.00	0.34
78	688347	华虹公司	74,216	3,448,817.52	0.34
79	600704	物产中大	676,900	3,425,114.00	0.33
80	300039	上海凯宝	552,698	3,415,673.64	0.33
81	300315	掌趣科技	621,000	3,415,500.00	0.33
82	600585	海螺水泥	142,500	3,388,650.00	0.33
83	002230	科大讯飞	70,000	3,382,400.00	0.33
84	002255	海陆重工	588,600	3,272,616.00	0.32
85	002594	比亚迪	11,500	3,250,590.00	0.32
86	600741	华域汽车	180,600	3,180,366.00	0.31
87	300059	东方财富	122,500	3,162,950.00	0.31
88	688223	晶科能源	443,673	3,154,515.03	0.31
89	600637	东方明珠	405,400	3,145,904.00	0.31
90	300033	同花顺	10,900	3,133,750.00	0.31
91	601068	中铝国际	700,500	3,089,205.00	0.30
92	301370	国科恒泰	284,500	3,072,600.00	0.30
93	002004	华邦健康	678,116	3,065,084.32	0.30
94	601138	工业富联	141,300	3,037,950.00	0.30
95	002293	罗莱生活	378,500	2,952,300.00	0.29
96	601608	中信重工	694,600	2,917,320.00	0.28
97	600703	三安光电	239,000	2,908,630.00	0.28
98	002204	大连重工	572,600	2,851,548.00	0.28
99	601728	中国电信	388,400	2,804,248.00	0.27
100	300398	飞凯材料	177,400	2,795,824.00	0.27
101	600017	日照港	870,300	2,784,960.00	0.27
102	688588	凌志软件	201,367	2,778,864.60	0.27
103	688256	寒武纪	4,202	2,764,916.00	0.27
104	603799	华友钴业	94,300	2,759,218.00	0.27
105	600900	长江电力	93,300	2,757,015.00	0.27
106	601598	中国外运	514,200	2,750,970.00	0.27
107	300618	寒锐钴业	79,200	2,674,584.00	0.26
108	301221	光庭信息	55,000	2,671,900.00	0.26
109	300726	宏达电子	85,600	2,662,160.00	0.26
110	600875	东方电气	166,500	2,645,685.00	0.26
111	603888	新华网	118,000	2,636,120.00	0.26
112	300400	劲拓股份	161,900	2,626,018.00	0.26
113	688506	百利天恒	13,407	2,570,524.11	0.25
114	002110	三钢闽光	759,300	2,520,876.00	0.25
115	000026	飞亚达	242,800	2,517,836.00	0.25

116	000966	长源电力	526,900	2,502,775.00	0.24
117	601600	中国铝业	340,200	2,500,470.00	0.24
118	300394	天孚通信	27,300	2,494,128.00	0.24
119	002033	丽江股份	276,500	2,452,555.00	0.24
120	000539	粤电力 A	539,300	2,443,029.00	0.24
121	002345	潮宏基	413,500	2,402,435.00	0.23
122	300722	新余国科	88,732	2,397,538.64	0.23
123	600196	复星医药	95,600	2,375,660.00	0.23
124	000900	现代投资	521,700	2,300,697.00	0.22
125	601666	平煤股份	228,400	2,288,568.00	0.22
126	002549	凯美特气	371,819	2,279,250.47	0.22
127	600546	山煤国际	192,600	2,278,458.00	0.22
128	300215	电科院	379,100	2,248,063.00	0.22
129	601688	华泰证券	125,600	2,209,304.00	0.22
130	600985	淮北矿业	152,600	2,147,082.00	0.21
131	300184	力源信息	228,900	2,135,637.00	0.21
132	600273	嘉化能源	266,400	2,123,208.00	0.21
133	600667	太极实业	306,500	2,120,980.00	0.21
134	300369	绿盟科技	293,100	2,107,389.00	0.21
135	688120	华海清科	12,800	2,086,272.00	0.20
136	002385	大北农	478,950	2,073,853.50	0.20
137	002303	美盈森	577,800	2,068,524.00	0.20
138	600812	华北制药	394,200	2,038,014.00	0.20
139	000559	万向钱潮	329,960	2,029,254.00	0.20
140	300531	优博讯	145,100	2,024,145.00	0.20
141	600968	海油发展	460,300	1,965,481.00	0.19
142	300759	康龙化成	76,400	1,963,480.00	0.19
143	300346	南大光电	50,000	1,929,500.00	0.19
144	300080	易成新能	435,900	1,904,883.00	0.19
145	301318	维海德	64,400	1,901,088.00	0.19
146	300507	苏奥传感	283,300	1,898,110.00	0.18
147	002626	金达威	124,900	1,885,990.00	0.18
148	600031	三一重工	113,900	1,877,072.00	0.18
149	000783	长江证券	268,300	1,829,806.00	0.18
150	300341	麦克奥迪	103,600	1,814,036.00	0.18
151	600153	建发股份	171,900	1,808,388.00	0.18
152	601106	中国一重	614,500	1,788,195.00	0.17
153	601369	陕鼓动力	203,000	1,766,100.00	0.17
154	688520	神州细胞	48,522	1,757,952.06	0.17
155	000850	华茂股份	425,200	1,756,076.00	0.17
156	688008	澜起科技	25,800	1,751,820.00	0.17
157	688209	英集芯	98,720	1,744,382.40	0.17
158	601328	交通银行	222,400	1,728,048.00	0.17

159	000932	华菱钢铁	411,200	1,718,816.00	0.17
160	601298	青岛港	183,700	1,673,507.00	0.16
161	000401	冀东水泥	318,200	1,664,186.00	0.16
162	300978	东箭科技	152,400	1,659,636.00	0.16
163	600028	中国石化	245,600	1,640,608.00	0.16
164	603893	瑞芯微	14,900	1,639,894.00	0.16
165	601618	中国中冶	489,500	1,615,350.00	0.16
166	601009	南京银行	150,900	1,607,085.00	0.16
167	002371	北方华创	4,100	1,603,100.00	0.16
168	688772	珠海冠宇	99,606	1,601,664.48	0.16
169	688617	惠泰医疗	4,300	1,601,019.00	0.16
170	000726	鲁泰 A	244,000	1,590,880.00	0.15
171	300674	宇信科技	81,000	1,581,120.00	0.15
172	300601	康泰生物	91,200	1,564,080.00	0.15
173	300160	秀强股份	287,300	1,562,912.00	0.15
174	300919	中伟股份	42,900	1,549,548.00	0.15
175	002459	晶澳科技	111,100	1,527,625.00	0.15
176	300434	金石亚药	184,500	1,522,125.00	0.15
177	300579	数字认证	47,200	1,483,024.00	0.14
178	600008	首创环保	451,400	1,480,592.00	0.14
179	300598	诚迈科技	30,560	1,479,104.00	0.14
180	601390	中国中铁	230,400	1,472,256.00	0.14
181	000683	远兴能源	262,100	1,465,139.00	0.14
182	688128	中国电研	69,625	1,462,821.25	0.14
183	300200	高盟新材	173,300	1,434,924.00	0.14
184	600309	万华化学	20,000	1,427,000.00	0.14
185	301025	读客文化	148,300	1,413,299.00	0.14
186	688111	金山办公	4,900	1,403,311.00	0.14
187	600380	健康元	124,496	1,403,069.92	0.14
188	600428	中远海特	191,200	1,395,760.00	0.14
189	000776	广发证券	86,100	1,395,681.00	0.14
190	300373	扬杰科技	32,000	1,392,640.00	0.14
191	600690	海尔智家	48,800	1,389,336.00	0.14
192	000858	五粮液	9,787	1,370,571.48	0.13
193	605499	东鹏饮料	5,500	1,366,860.00	0.13
194	002036	联创电子	144,700	1,360,180.00	0.13
195	000100	TCL 科技	269,900	1,357,597.00	0.13
196	600570	恒生电子	48,500	1,357,515.00	0.13
197	300207	欣旺达	60,800	1,356,448.00	0.13
198	600744	华银电力	429,300	1,335,123.00	0.13
199	002920	德赛西威	12,100	1,332,331.00	0.13
200	300339	润和软件	26,600	1,330,798.00	0.13
201	000651	格力电器	29,200	1,327,140.00	0.13

202	002241	歌尔股份	51,300	1,324,053.00	0.13
203	601555	东吴证券	167,900	1,309,620.00	0.13
204	688579	山大地纬	142,144	1,306,303.36	0.13
205	002538	司尔特	231,800	1,302,716.00	0.13
206	002446	盛路通信	197,830	1,295,786.50	0.13
207	301112	信邦智能	55,300	1,292,361.00	0.13
208	002703	浙江世宝	112,800	1,282,536.00	0.12
209	002415	海康威视	41,500	1,274,050.00	0.12
210	600809	山西汾酒	6,900	1,271,049.00	0.12
211	300757	罗博特科	5,600	1,261,792.00	0.12
212	003816	中国广核	305,000	1,259,650.00	0.12
213	600681	百川能源	359,900	1,259,650.00	0.12
214	000009	中国宝安	137,300	1,256,295.00	0.12
215	688553	汇宇制药	82,430	1,252,936.00	0.12
216	000920	沃顿科技	139,400	1,243,448.00	0.12
217	688509	正元地信	311,987	1,238,588.39	0.12
218	002284	亚太股份	159,600	1,235,304.00	0.12
219	600219	南山铝业	315,100	1,232,041.00	0.12
220	002548	金新农	308,400	1,224,348.00	0.12
221	002506	协鑫集成	452,100	1,207,107.00	0.12
222	688009	中国通号	191,335	1,197,757.10	0.12
223	002250	联化科技	216,300	1,191,813.00	0.12
224	300424	航新科技	65,600	1,184,736.00	0.12
225	600853	龙建股份	294,900	1,179,600.00	0.11
226	002984	森麒麟	47,800	1,178,748.00	0.11
227	600406	国电南瑞	46,400	1,170,208.00	0.11
228	688313	仕佳光子	70,609	1,157,281.51	0.11
229	002083	孚日股份	236,386	1,155,927.54	0.11
230	002938	鹏鼎控股	31,600	1,152,768.00	0.11
231	002558	巨人网络	90,700	1,150,983.00	0.11
232	688099	晶晨股份	16,757	1,150,870.76	0.11
233	300533	冰川网络	57,800	1,142,128.00	0.11
234	600027	华电国际	203,200	1,139,952.00	0.11
235	688306	均普智能	146,828	1,137,917.00	0.11
236	300281	金明精机	203,100	1,135,329.00	0.11
237	300054	鼎龙股份	43,600	1,134,472.00	0.11
238	300735	光弘科技	39,700	1,111,203.00	0.11
239	601098	中南传媒	73,600	1,104,736.00	0.11
240	688538	和辉光电	473,805	1,099,227.60	0.11
241	600073	光明肉业	158,100	1,097,214.00	0.11
242	600722	金牛化工	233,500	1,092,780.00	0.11
243	301121	紫建电子	20,500	1,087,730.00	0.11
244	002668	TCL 智家	82,700	1,085,024.00	0.11

245	301282	金禄电子	50,400	1,055,880.00	0.10
246	600999	招商证券	54,300	1,040,388.00	0.10
247	002032	苏泊尔	19,402	1,032,380.42	0.10
248	600305	恒顺醋业	129,200	1,031,016.00	0.10
249	300459	汤姆猫	179,200	1,028,608.00	0.10
250	603551	奥普科技	95,800	1,023,144.00	0.10
251	002185	华天科技	88,000	1,021,680.00	0.10
252	002714	牧原股份	26,500	1,018,660.00	0.10
253	688568	中科星图	19,917	1,016,364.51	0.10
254	688380	中微半导	33,930	1,014,507.00	0.10
255	688472	阿特斯	80,700	1,013,592.00	0.10
256	600779	水井坊	18,900	1,011,528.00	0.10
257	000419	通程控股	176,800	1,009,528.00	0.10
258	300115	长盈精密	61,800	1,003,632.00	0.10
259	603890	春秋电子	85,300	1,002,275.00	0.10
260	000017	深中华 A	166,900	968,020.00	0.09
261	300447	全信股份	68,200	966,394.00	0.09
262	300988	津荣天宇	53,500	965,140.00	0.09
263	688107	安路科技	32,509	961,616.22	0.09
264	300011	鼎汉技术	132,000	960,960.00	0.09
265	300505	川金诺	66,400	956,160.00	0.09
266	600664	哈药股份	229,900	949,487.00	0.09
267	601012	隆基绿能	59,700	937,887.00	0.09
268	000957	中通客车	84,400	928,400.00	0.09
269	300477	合纵科技	323,560	918,910.40	0.09
270	300666	江丰电子	13,200	916,740.00	0.09
271	002376	新北洋	139,459	909,272.68	0.09
272	301132	满坤科技	32,700	899,250.00	0.09
273	600660	福耀玻璃	14,400	898,560.00	0.09
274	601668	中国建筑	148,860	893,160.00	0.09
275	002565	顺灏股份	293,600	892,544.00	0.09
276	600879	航天电子	99,600	892,416.00	0.09
277	000417	合百集团	138,800	885,544.00	0.09
278	002061	浙江交科	216,800	884,544.00	0.09
279	600550	保变电气	111,500	875,275.00	0.09
280	002818	富森美	56,700	847,098.00	0.08
281	600790	轻纺城	225,000	843,750.00	0.08
282	300645	正元智慧	56,600	831,454.00	0.08
283	000768	中航西飞	29,000	818,960.00	0.08
284	688348	昱能科技	16,679	813,935.20	0.08
285	300413	芒果超媒	30,200	812,078.00	0.08
286	300002	神州泰岳	69,600	806,664.00	0.08
287	600938	中国海油	27,300	805,623.00	0.08

288	600176	中国巨石	70,300	800,717.00	0.08
289	688543	国科军工	15,812	792,497.44	0.08
290	601166	兴业银行	41,300	791,308.00	0.08
291	688590	新致软件	49,243	789,365.29	0.08
292	000938	紫光股份	28,300	787,589.00	0.08
293	002662	京威股份	203,100	785,997.00	0.08
294	300438	鹏辉能源	27,900	784,269.00	0.08
295	300729	乐歌股份	47,700	757,476.00	0.07
296	688012	中微公司	4,000	756,640.00	0.07
297	300570	太辰光	10,400	756,080.00	0.07
298	000039	中集集团	97,200	755,244.00	0.07
299	601992	金隅集团	419,300	746,354.00	0.07
300	300699	光威复材	21,200	734,580.00	0.07
301	300634	彩讯股份	33,300	725,940.00	0.07
302	603687	大胜达	99,500	725,355.00	0.07
303	300682	朗新集团	58,900	718,580.00	0.07
304	300581	晨曦航空	62,900	705,109.00	0.07
305	002375	亚厦股份	182,600	704,836.00	0.07
306	300292	吴通控股	143,800	697,430.00	0.07
307	002648	卫星化学	37,100	697,109.00	0.07
308	601018	宁波港	180,600	695,310.00	0.07
309	601117	中国化学	83,600	693,044.00	0.07
310	688126	沪硅产业	36,490	686,741.80	0.07
311	600098	广州发展	106,900	686,298.00	0.07
312	688312	燕麦科技	21,979	676,953.20	0.07
313	002613	北玻股份	167,400	676,296.00	0.07
314	603993	洛阳钼业	100,900	670,985.00	0.07
315	002562	兄弟科技	155,900	662,575.00	0.06
316	300492	华图山鼎	9,100	662,480.00	0.06
317	002926	华西证券	79,700	662,307.00	0.06
318	002164	宁波东力	131,300	657,813.00	0.06
319	688425	铁建重工	149,400	657,360.00	0.06
320	601877	正泰电器	27,800	650,798.00	0.06
321	600460	士兰微	25,000	650,500.00	0.06
322	600536	中国软件	13,900	648,991.00	0.06
323	600284	浦东建设	103,300	647,691.00	0.06
324	000931	中关村	135,300	644,028.00	0.06
325	301175	中科环保	119,100	643,140.00	0.06
326	300724	捷佳伟创	10,100	638,421.00	0.06
327	600727	鲁北化工	85,800	635,778.00	0.06
328	601168	西部矿业	39,400	633,158.00	0.06
329	600987	航民股份	90,900	630,846.00	0.06
330	603087	甘李药业	14,300	630,630.00	0.06

331	605117	德业股份	7,400	627,520.00	0.06
332	300514	友讯达	43,100	622,364.00	0.06
333	600367	红星发展	53,800	620,852.00	0.06
334	688586	江航装备	64,786	620,002.02	0.06
335	002456	欧菲光	50,600	606,188.00	0.06
336	688660	电气风电	66,800	601,200.00	0.06
337	600482	中国动力	24,500	599,515.00	0.06
338	601339	百隆东方	110,000	598,400.00	0.06
339	603296	华勤技术	8,400	595,980.00	0.06
340	002327	富安娜	66,500	587,860.00	0.06
341	001216	华瓷股份	46,000	586,500.00	0.06
342	688180	君实生物	21,100	576,663.00	0.06
343	600644	乐山电力	93,500	572,220.00	0.06
344	300012	华测检测	46,000	571,780.00	0.06
345	300696	爱乐达	36,800	571,504.00	0.06
346	601188	龙江交通	158,200	569,520.00	0.06
347	600583	海油工程	104,000	568,880.00	0.06
348	002550	千红制药	91,400	566,680.00	0.06
349	300672	国科微	8,400	560,700.00	0.05
350	688396	华润微	11,747	554,340.93	0.05
351	605299	舒华体育	70,200	553,878.00	0.05
352	301029	怡合达	22,300	551,256.00	0.05
353	002001	新和成	24,900	547,053.00	0.05
354	000948	南天信息	32,600	545,398.00	0.05
355	300763	锦浪科技	8,900	543,523.00	0.05
356	601898	中煤能源	44,100	537,138.00	0.05
357	688148	芳源股份	107,915	534,179.25	0.05
358	600248	陕建股份	118,200	529,536.00	0.05
359	688055	龙腾光电	127,744	527,582.72	0.05
360	688079	美迪凯	60,573	524,562.18	0.05
361	300545	联得装备	16,600	520,078.00	0.05
362	600039	四川路桥	69,900	508,872.00	0.05
363	600023	浙能电力	88,800	502,608.00	0.05
364	300648	星云股份	21,700	499,100.00	0.05
365	601222	林洋能源	68,900	487,123.00	0.05
366	002906	华阳集团	15,800	485,850.00	0.05
367	002578	闽发铝业	159,900	478,101.00	0.05
368	600970	中材国际	50,000	474,000.00	0.05
369	300576	容大感光	10,400	469,872.00	0.05
370	600021	上海电力	50,700	464,919.00	0.05
371	300558	贝达药业	8,600	463,798.00	0.05
372	688337	普源精电	11,777	459,303.00	0.04
373	000338	潍柴动力	33,500	458,950.00	0.04

374	300142	沃森生物	37,200	449,376.00	0.04
375	300241	瑞丰光电	80,500	441,945.00	0.04
376	688609	九联科技	41,381	438,638.60	0.04
377	688122	西部超导	10,200	436,764.00	0.04
378	000728	国元证券	51,900	433,884.00	0.04
379	300760	迈瑞医疗	1,700	433,500.00	0.04
380	688187	时代电气	8,900	426,488.00	0.04
381	000921	海信家电	14,700	424,830.00	0.04
382	002912	中新赛克	16,600	424,794.00	0.04
383	603230	内蒙新华	33,500	424,110.00	0.04
384	000997	新大陆	21,200	422,940.00	0.04
385	300277	海联讯	37,500	422,625.00	0.04
386	003039	顺控发展	32,200	421,176.00	0.04
387	300306	远方信息	36,300	421,080.00	0.04
388	300018	中元股份	61,800	418,386.00	0.04
389	600495	晋西车轴	108,900	413,820.00	0.04
390	688599	天合光能	21,300	411,090.00	0.04
391	301078	孩子王	36,100	410,818.00	0.04
392	000425	徐工机械	51,600	409,188.00	0.04
393	002535	林州重机	105,500	404,065.00	0.04
394	002567	唐人神	79,000	402,900.00	0.04
395	301052	果麦文化	15,600	396,864.00	0.04
396	301036	双乐股份	10,100	395,920.00	0.04
397	601066	中信建投	15,300	393,975.00	0.04
398	002705	新宝股份	26,200	393,000.00	0.04
399	603000	人民网	17,700	390,108.00	0.04
400	002536	飞龙股份	33,600	389,088.00	0.04
401	600661	昂立教育	32,900	385,588.00	0.04
402	300409	道氏技术	28,200	383,802.00	0.04
403	600415	小商品城	28,500	382,185.00	0.04
404	002151	北斗星通	14,400	382,176.00	0.04
405	600819	耀皮玻璃	71,000	381,270.00	0.04
406	300357	我武生物	18,600	377,952.00	0.04
407	600300	维维股份	116,700	375,774.00	0.04
408	601939	建设银行	42,700	375,333.00	0.04
409	002852	道道全	45,300	374,178.00	0.04
410	601116	三江购物	34,300	373,184.00	0.04
411	601628	中国人寿	8,900	373,088.00	0.04
412	300193	佳士科技	41,600	369,824.00	0.04
413	001286	陕西能源	39,800	369,344.00	0.04
414	300445	康斯特	22,700	369,329.00	0.04
415	688070	纵横股份	10,356	365,566.80	0.04
416	002469	三维化学	49,600	362,080.00	0.04

417	300541	先进数通	26,600	360,430.00	0.04
418	600468	百利电气	76,300	358,610.00	0.03
419	300194	福安药业	79,900	356,354.00	0.03
420	688522	纳睿雷达	6,200	349,308.00	0.03
421	300088	长信科技	53,400	349,236.00	0.03
422	300529	健帆生物	11,800	346,212.00	0.03
423	301312	智立方	7,120	346,032.00	0.03
424	000978	桂林旅游	57,000	344,280.00	0.03
425	002361	神剑股份	63,100	343,895.00	0.03
426	688252	天德钰	14,300	342,485.00	0.03
427	601326	秦港股份	101,500	340,025.00	0.03
428	000792	盐湖股份	20,500	337,430.00	0.03
429	600769	祥龙电业	34,700	333,467.00	0.03
430	601949	中国出版	46,000	330,280.00	0.03
431	300638	广和通	16,300	328,445.00	0.03
432	600351	亚宝药业	53,801	327,648.09	0.03
433	300493	润欣科技	11,600	326,308.00	0.03
434	600489	中金黄金	27,100	326,013.00	0.03
435	000963	华东医药	9,400	325,240.00	0.03
436	300684	中石科技	14,400	322,992.00	0.03
437	600531	豫光金铅	49,500	317,790.00	0.03
438	000568	泸州老窖	2,500	313,000.00	0.03
439	600619	海立股份	25,300	308,660.00	0.03
440	601083	锦江航运	32,300	307,496.00	0.03
441	688550	瑞联新材	9,700	303,513.00	0.03
442	002406	远东传动	45,900	296,055.00	0.03
443	300766	每日互动	20,200	295,122.00	0.03
444	002556	辉隆股份	52,800	294,096.00	0.03
445	000987	越秀资本	41,300	289,926.00	0.03
446	601669	中国电建	52,600	287,196.00	0.03
447	300225	金力泰	44,200	285,532.00	0.03
448	300567	精测电子	4,300	276,490.00	0.03
449	600906	财达证券	38,700	274,770.00	0.03
450	002500	山西证券	43,700	274,436.00	0.03
451	601696	中银证券	24,500	273,420.00	0.03
452	300781	因赛集团	4,600	271,538.00	0.03
453	002008	大族激光	10,400	260,000.00	0.03
454	002228	合兴包装	85,900	257,700.00	0.03
455	002421	达实智能	74,400	255,192.00	0.02
456	601991	大唐发电	89,200	254,220.00	0.02
457	603927	中科软	11,600	251,720.00	0.02
458	600141	兴发集团	11,400	247,380.00	0.02
459	600592	龙溪股份	25,000	247,000.00	0.02

460	002471	中超控股	89,800	245,154.00	0.02
461	300975	商络电子	21,700	244,125.00	0.02
462	300827	上能电气	5,500	241,450.00	0.02
463	600352	浙江龙盛	23,400	240,786.00	0.02
464	600398	海澜之家	32,100	240,750.00	0.02
465	600573	惠泉啤酒	21,100	237,586.00	0.02
466	300943	春晖智控	18,400	237,176.00	0.02
467	300643	万通智控	19,700	235,612.00	0.02
468	600595	中孚实业	83,100	235,173.00	0.02
469	003025	思进智能	16,645	234,528.05	0.02
470	600348	华阳股份	32,900	233,261.00	0.02
471	002734	利民股份	29,200	232,724.00	0.02
472	002615	哈尔斯	29,200	232,140.00	0.02
473	002545	东方铁塔	33,000	231,990.00	0.02
474	300751	迈为股份	2,200	231,330.00	0.02
475	600362	江西铜业	11,200	231,168.00	0.02
476	000965	天保基建	76,995	230,985.00	0.02
477	002693	双成药业	12,600	230,958.00	0.02
478	600470	六国化工	42,000	229,320.00	0.02
479	300136	信维通信	9,000	228,960.00	0.02
480	603266	天龙股份	14,200	228,620.00	0.02
481	300176	鸿特科技	33,000	228,360.00	0.02
482	300484	蓝海华腾	11,000	227,260.00	0.02
483	600101	明星电力	25,800	227,040.00	0.02
484	002160	常铝股份	60,600	225,432.00	0.02
485	603823	百合花	23,920	222,456.00	0.02
486	002337	赛象科技	44,700	222,159.00	0.02
487	002248	华东数控	28,400	221,236.00	0.02
488	300968	格林精密	13,400	220,832.00	0.02
489	300758	七彩化学	18,400	220,432.00	0.02
490	300283	温州宏丰	39,900	219,051.00	0.02
491	300101	振芯科技	10,100	218,766.00	0.02
492	301338	凯格精机	7,000	218,400.00	0.02
493	300890	翔丰华	7,200	217,872.00	0.02
494	600717	天津港	44,700	217,689.00	0.02
495	603933	睿能科技	14,000	217,560.00	0.02
496	000830	鲁西化工	18,600	217,434.00	0.02
497	300539	横河精密	20,460	217,285.20	0.02
498	002367	康力电梯	31,400	215,718.00	0.02
499	002358	森源电气	46,800	215,280.00	0.02
500	301369	联动科技	4,100	214,758.00	0.02
501	603373	安邦护卫	7,100	212,219.00	0.02
502	002365	永安药业	26,553	212,158.47	0.02

503	002686	亿利达	39,400	211,184.00	0.02
504	301138	华研精机	7,900	210,851.00	0.02
505	688508	芯朋微	4,900	210,553.00	0.02
506	688602	康鹏科技	30,200	208,682.00	0.02
507	000596	古井贡酒	1,200	207,960.00	0.02
508	002634	棒杰股份	55,100	207,176.00	0.02
509	301320	豪江智能	13,800	205,758.00	0.02
510	000701	厦门信达	45,000	205,650.00	0.02
511	002180	纳思达	7,300	205,641.00	0.02
512	301205	联特科技	2,700	204,363.00	0.02
513	300546	雄帝科技	11,900	200,158.00	0.02
514	300654	世纪天鸿	19,800	199,782.00	0.02
515	300812	易天股份	9,000	198,360.00	0.02
516	601002	晋亿实业	45,400	197,490.00	0.02
517	002559	亚威股份	22,000	197,340.00	0.02
518	600268	国电南自	29,193	196,176.96	0.02
519	002782	可立克	15,500	196,075.00	0.02
520	600386	北巴传媒	43,600	194,892.00	0.02
521	002900	哈三联	19,600	193,060.00	0.02
522	600030	中信证券	6,600	192,522.00	0.02
523	688192	迪哲医药	4,600	190,762.00	0.02
524	301378	通达海	6,600	189,024.00	0.02
525	002028	思源电气	2,600	189,020.00	0.02
526	600222	太龙药业	37,100	188,839.00	0.02
527	002909	集泰股份	37,400	185,878.00	0.02
528	000068	华控赛格	55,000	184,250.00	0.02
529	600011	华能国际	27,100	183,467.00	0.02
530	300925	法本信息	8,200	182,696.00	0.02
531	000554	泰山石油	30,400	180,576.00	0.02
532	688015	交控科技	9,100	180,453.00	0.02
533	300454	深信服	3,100	177,940.00	0.02
534	603079	圣达生物	13,100	176,457.00	0.02
535	002772	众兴菌业	23,899	176,135.63	0.02
536	600276	恒瑞医药	3,800	174,420.00	0.02
537	000677	恒天海龙	42,200	173,020.00	0.02
538	600558	大西洋	42,500	172,975.00	0.02
539	002688	金河生物	38,600	172,542.00	0.02
540	002666	德联集团	39,400	171,784.00	0.02
541	002866	传艺科技	10,500	169,890.00	0.02
542	300917	特发服务	3,500	169,330.00	0.02
543	600162	香江控股	88,100	169,152.00	0.02
544	605337	李子园	14,900	168,221.00	0.02
545	301016	雷尔伟	7,900	165,584.00	0.02

546	600372	中航机载	13,400	165,222.00	0.02
547	603386	骏亚科技	14,800	164,576.00	0.02
548	600439	瑞贝卡	48,600	163,782.00	0.02
549	600340	华夏幸福	60,600	163,014.00	0.02
550	000626	远大控股	27,900	160,425.00	0.02
551	002655	共达电声	12,600	160,398.00	0.02
552	001208	华菱线缆	17,500	158,900.00	0.02
553	300250	初灵信息	11,200	157,920.00	0.02
554	300731	科创新源	7,300	157,753.00	0.02
555	603739	蔚蓝生物	13,100	157,069.00	0.02
556	603596	伯特利	3,500	156,065.00	0.02
557	002201	正威新材	30,000	155,700.00	0.02
558	301413	安培龙	2,900	155,179.00	0.02
559	600990	四创电子	7,250	154,280.00	0.02
560	600109	国金证券	17,600	153,648.00	0.01
561	002474	榕基软件	25,400	152,146.00	0.01
562	000973	佛塑科技	25,400	150,876.00	0.01
563	300922	天秦装备	10,400	149,240.00	0.01
564	300016	北陆药业	23,850	147,870.00	0.01
565	301488	豪恩汽电	2,600	143,754.00	0.01
566	002689	远大智能	41,100	143,439.00	0.01
567	300746	汉嘉设计	12,500	142,625.00	0.01
568	002835	同为股份	7,400	142,080.00	0.01
569	688419	耐科装备	4,488	139,487.04	0.01
570	002722	物产金轮	9,800	138,964.00	0.01
571	300508	维宏股份	5,100	137,955.00	0.01
572	002352	顺丰控股	3,400	137,020.00	0.01
573	002957	科瑞技术	8,700	136,503.00	0.01
574	000153	丰原药业	21,900	134,247.00	0.01
575	601022	宁波远洋	16,700	134,101.00	0.01
576	300771	智莱科技	12,400	130,448.00	0.01
577	601007	金陵饭店	18,600	130,386.00	0.01
578	600909	华安证券	21,400	129,684.00	0.01
579	603076	乐惠国际	5,600	129,024.00	0.01
580	301226	祥明智能	5,500	127,710.00	0.01
581	603323	苏农银行	24,000	126,960.00	0.01
582	002412	汉森制药	21,100	126,811.00	0.01
583	002064	华峰化学	15,400	125,972.00	0.01
584	600665	天地源	39,500	123,635.00	0.01
585	301387	光大同创	3,600	123,480.00	0.01
586	300661	圣邦股份	1,500	122,670.00	0.01
587	000514	渝开发	29,700	122,067.00	0.01
588	300151	昌红科技	7,100	120,700.00	0.01

589	002825	纳尔股份	15,275	119,450.50	0.01
590	002823	凯中精密	8,400	119,028.00	0.01
591	300690	双一科技	5,200	117,572.00	0.01
592	301408	华人健康	10,600	116,918.00	0.01
593	300616	尚品宅配	9,500	116,375.00	0.01
594	600735	新华锦	25,500	116,280.00	0.01
595	603628	清源股份	9,300	116,064.00	0.01
596	301208	中亦科技	3,000	115,650.00	0.01
597	002803	吉宏股份	9,100	115,388.00	0.01
598	688152	麒麟信安	2,200	114,488.00	0.01
599	688088	虹软科技	2,900	111,824.00	0.01
600	688228	开普云	2,400	106,944.00	0.01
601	300560	中富通	6,900	106,812.00	0.01
602	002671	龙泉股份	23,500	106,455.00	0.01
603	002845	同兴达	6,900	104,604.00	0.01
604	002786	银宝山新	11,100	102,675.00	0.01
605	300335	迪森股份	21,300	102,666.00	0.01
606	300172	中电环保	20,284	102,434.20	0.01
607	003015	日久光电	7,100	101,601.00	0.01
608	300032	金龙机电	22,300	100,573.00	0.01
609	600919	江苏银行	10,200	100,164.00	0.01
610	600866	星湖科技	15,400	99,638.00	0.01
611	002627	三峡旅游	19,800	99,396.00	0.01
612	600998	九州通	19,300	98,816.00	0.01
613	600237	铜峰电子	14,900	97,595.00	0.01
614	300232	洲明科技	14,100	96,867.00	0.01
615	688652	京仪装备	1,900	93,290.00	0.01
616	000715	中兴商业	13,200	91,740.00	0.01
617	001979	招商蛇口	8,900	91,136.00	0.01
618	300404	博济医药	10,400	90,792.00	0.01
619	688658	悦康药业	6,300	90,783.00	0.01
620	002442	龙星化工	14,900	89,549.00	0.01
621	600756	浪潮软件	6,200	88,846.00	0.01
622	300099	尤洛卡	14,800	88,800.00	0.01
623	301041	金百泽	3,700	88,800.00	0.01
624	002394	联发股份	11,800	88,736.00	0.01
625	300342	天银机电	5,400	87,642.00	0.01
626	002758	浙农股份	10,000	87,500.00	0.01
627	002553	南方精工	6,800	87,448.00	0.01
628	300421	力星股份	7,700	86,163.00	0.01
629	002437	誉衡药业	34,000	84,660.00	0.01
630	002167	东方锆业	11,500	84,410.00	0.01
631	300261	雅本化学	12,300	84,255.00	0.01

632	601231	环旭电子	5,100	84,150.00	0.01
633	300047	天源迪科	7,100	83,425.00	0.01
634	301311	昆船智能	4,600	83,214.00	0.01
635	002768	国恩股份	3,600	83,052.00	0.01
636	300578	会畅通讯	4,300	82,775.00	0.01
637	002420	毅昌科技	15,500	81,840.00	0.01
638	300230	永利股份	18,300	81,435.00	0.01
639	688502	茂莱光学	400	80,560.00	0.01
640	600522	中天科技	5,600	80,192.00	0.01
641	600858	银座股份	14,400	79,920.00	0.01
642	688496	清越科技	9,275	79,486.75	0.01
643	002300	太阳电缆	14,600	77,964.00	0.01
644	601113	华鼎股份	19,400	75,660.00	0.01
645	300221	银禧科技	12,900	75,336.00	0.01
646	601816	京沪高铁	12,200	75,152.00	0.01
647	601156	东航物流	4,400	74,228.00	0.01
648	002584	西陇科学	10,200	73,338.00	0.01
649	300608	思特奇	6,700	72,896.00	0.01
650	600958	东方证券	6,800	71,808.00	0.01
651	300632	光莆股份	6,400	70,976.00	0.01
652	603038	华立股份	4,300	70,305.00	0.01
653	688222	成都先导	5,700	70,224.00	0.01
654	600262	北方股份	3,800	69,578.00	0.01
655	301389	隆扬电子	4,100	68,552.00	0.01
656	000533	顺钠股份	11,100	67,266.00	0.01
657	600622	光大嘉宝	20,600	66,538.00	0.01
658	603387	基蛋生物	8,000	66,000.00	0.01
659	301326	捷邦科技	900	65,790.00	0.01
660	603626	科森科技	8,400	65,520.00	0.01
661	000524	岭南控股	6,700	64,856.00	0.01
662	002590	万安科技	5,300	64,766.00	0.01
663	600392	盛和资源	6,300	64,764.00	0.01
664	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.01
665	301489	思泉新材	900	61,416.00	0.01
666	301376	致欧科技	3,200	61,184.00	0.01
667	300987	川网传媒	4,200	59,472.00	0.01
668	002636	金安国纪	7,500	58,050.00	0.01
669	301526	国际复材	15,000	55,500.00	0.01
670	002570	贝因美	12,700	53,467.00	0.01
671	688010	福光股份	1,859	52,981.50	0.01
672	002162	悦心健康	14,623	50,595.58	0.00
673	301099	雅创电子	1,200	49,740.00	0.00
674	688615	合合信息	289	47,910.42	0.00

675	002869	金溢科技	1,800	47,880.00	0.00
676	603082	北自科技	1,400	47,460.00	0.00
677	002368	太极股份	2,000	47,360.00	0.00
678	000709	河钢股份	21,400	47,294.00	0.00
679	688625	呈和科技	1,200	45,816.00	0.00
680	300512	中亚股份	6,700	45,627.00	0.00
681	601999	出版传媒	7,200	45,144.00	0.00
682	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.00
683	300402	宝色股份	3,000	44,250.00	0.00
684	603118	共进股份	4,900	43,610.00	0.00
685	002212	天融信	6,600	42,570.00	0.00
686	300228	富瑞特装	6,000	42,300.00	0.00
687	300337	银邦股份	3,800	42,256.00	0.00
688	688798	艾为电子	600	41,892.00	0.00
689	688591	泰凌微	1,322	41,510.80	0.00
690	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00
691	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.00
692	301393	昊帆生物	1,000	39,910.00	0.00
693	300822	贝仕达克	1,900	39,235.00	0.00
694	002208	合肥城建	5,500	39,105.00	0.00
695	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
696	002612	朗姿股份	2,300	37,628.00	0.00
697	688247	宣泰医药	3,704	37,262.24	0.00
698	300149	睿智医药	5,800	37,236.00	0.00
699	300290	荣科科技	1,800	36,630.00	0.00
700	002196	方正电机	6,700	35,912.00	0.00
701	605567	春雪食品	3,900	35,100.00	0.00
702	300519	新光药业	2,600	34,502.00	0.00
703	603011	合锻智能	5,000	34,250.00	0.00
704	002779	中坚科技	500	34,000.00	0.00
705	300797	钢研纳克	2,800	33,068.00	0.00
706	300542	新晨科技	1,600	32,864.00	0.00
707	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
708	688418	震有科技	1,095	31,930.20	0.00
709	000407	胜利股份	8,400	28,728.00	0.00
710	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
711	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
712	601956	东贝集团	5,600	27,048.00	0.00
713	301183	东田微	500	26,900.00	0.00
714	300092	科新机电	2,300	26,542.00	0.00
715	688663	新风光	1,200	26,052.00	0.00
716	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.00
717	600610	中毅达	6,000	25,380.00	0.00

718	688005	容百科技	800	25,240.00	0.00
719	000833	粤桂股份	2,200	25,014.00	0.00
720	300308	中际旭创	200	24,702.00	0.00
721	301281	科源制药	800	23,928.00	0.00
722	300082	奥克股份	3,800	23,826.00	0.00
723	601599	浙文影业	6,600	23,628.00	0.00
724	002106	莱宝高科	2,100	22,911.00	0.00
725	002642	荣联科技	3,200	22,880.00	0.00
726	600057	厦门象屿	3,500	22,715.00	0.00
727	001268	联合精密	1,300	22,698.00	0.00
728	002301	齐心集团	3,100	22,041.00	0.00
729	603214	爱婴室	900	20,304.00	0.00
730	300375	鹏翎股份	4,400	20,284.00	0.00
731	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
732	000993	闽东电力	2,300	19,205.00	0.00
733	002017	东信和平	1,800	18,666.00	0.00
734	002790	瑞尔特	2,500	18,250.00	0.00
735	002479	富春环保	3,600	17,064.00	0.00
736	002334	英威腾	2,200	16,544.00	0.00
737	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
738	301301	川宁生物	1,300	15,418.00	0.00
739	301327	华宝新能	200	15,342.00	0.00
740	300730	科创信息	1,200	14,604.00	0.00
741	000888	峨眉山 A	1,100	14,553.00	0.00
742	600686	金龙汽车	1,000	14,060.00	0.00
743	603818	曲美家居	5,100	13,872.00	0.00
744	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
745	600438	通威股份	600	13,266.00	0.00
746	300407	凯发电气	1,300	13,221.00	0.00
747	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
748	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
749	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
750	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
751	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
752	300206	理邦仪器	900	10,062.00	0.00
753	688325	赛微微电	200	9,920.00	0.00
754	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
755	300453	三鑫医疗	1,300	9,698.00	0.00
756	002981	朝阳科技	400	9,328.00	0.00
757	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
758	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
759	002546	新联电子	1,500	6,495.00	0.00
760	002969	嘉美包装	1,900	5,909.00	0.00

761	603111	康尼机电	900	5,427.00	0.00
762	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
763	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
764	688362	甬矽电子	127	4,277.36	0.00
765	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
766	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
767	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
768	688249	晶合集成	136	3,174.24	0.00
769	688563	航材股份	35	1,954.40	0.00
770	688428	诺诚健华	43	528.04	0.00
771	688141	杰华特	11	336.71	0.00
772	603886	元祖股份	20	288.40	0.00
773	600212	绿能慧充	36	272.16	0.00
774	688722	同益中	20	255.00	0.00
775	600839	四川长虹	21	202.65	0.00
776	600449	宁夏建材	11	165.22	0.00
777	300858	科拓生物	10	143.80	0.00
778	688371	菲沃泰	9	139.68	0.00
779	002342	巨力索具	42	135.66	0.00
780	688183	生益电子	3	117.78	0.00
781	688131	皓元医药	2	71.40	0.00
782	688182	灿勤科技	2	35.76	0.00
783	600606	绿地控股	16	33.60	0.00
784	000876	新希望	2	17.96	0.00
785	000551	创元科技	1	11.96	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600276	恒瑞医药	86,440,252.60	3.29
2	601318	中国平安	85,852,809.68	3.27
3	300750	宁德时代	68,801,360.40	2.62
4	601628	中国人寿	66,634,110.46	2.54
5	601857	中国石油	66,303,263.04	2.53
6	601728	中国电信	64,867,383.00	2.47
7	000568	泸州老窖	64,825,882.94	2.47
8	600519	贵州茅台	63,950,491.00	2.44
9	600028	中国石化	63,340,057.80	2.41
10	601633	长城汽车	63,200,928.81	2.41
11	000725	京东方 A	61,835,618.00	2.36

12	600050	中国联通	61,341,532.00	2.34
13	601766	中国中车	60,430,533.60	2.30
14	601398	工商银行	54,324,115.00	2.07
15	601668	中国建筑	52,128,101.00	1.99
16	601319	中国人保	51,374,307.00	1.96
17	002475	立讯精密	49,866,349.75	1.90
18	601600	中国铝业	48,535,620.00	1.85
19	601899	紫金矿业	48,474,805.87	1.85
20	601138	工业富联	48,184,861.00	1.84

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600276	恒瑞医药	86,711,852.46	3.30
2	601318	中国平安	76,619,791.16	2.92
3	601857	中国石油	74,978,337.36	2.86
4	600028	中国石化	73,185,280.60	2.79
5	601728	中国电信	70,987,774.00	2.70
6	000568	泸州老窖	70,832,534.39	2.70
7	601633	长城汽车	69,341,203.04	2.64
8	601628	中国人寿	68,441,460.20	2.61
9	600050	中国联通	64,063,104.00	2.44
10	601766	中国中车	59,825,848.85	2.28
11	601600	中国铝业	58,285,684.00	2.22
12	601319	中国人保	57,412,622.00	2.19
13	000725	京东方 A	55,524,090.00	2.12
14	300750	宁德时代	53,944,667.73	2.06
15	600519	贵州茅台	53,915,249.75	2.05
16	600582	天地科技	53,527,973.96	2.04
17	601668	中国建筑	52,908,439.60	2.02
18	002001	新和成	51,861,797.86	1.98
19	000651	格力电器	51,646,110.00	1.97
20	601398	工商银行	50,577,593.16	1.93

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	20,067,346,040.05
卖出股票收入（成交）总额	21,508,079,057.66

注：买入股票成本（成交）总额和卖出股票收入（成交）总额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将按照风险管理原则，以套期保值为目的，依据审慎原则适当参与股指期货投资。本基金将分析股指期货的风险收益特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，利用股指期货的杠杆作用和流动性较好的特点，及时调整投资组合的仓位及风险暴露，以提高组合的运作效率，降低基金资产调整的频率和交易成本，并更好地应对大额申购赎回等流动性风险。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金将按照风险管理原则，以套期保值为目的，依据审慎原则适度参与国债期货投资。本基金运用国债期货对冲风险，利用国债期货的杠杆作用和流动性较好的特点，灵活运用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，降低基金资产调整的频率和交易成本。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金持有的前十名证券发行主体中国光大银行股份有限公司，2024 年 5 月，因违规经营被国家金融监督管理总局罚款，其分支行 2024 年多次因违规，被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行罚款、警示等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国农业银行股份有限公司，2024 年其分支行多次违规，被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局、证监会分局罚款、警示等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国银行股份有限公司，2024 年 1 月因信息报送异常不及时整改被国家金融监督管理总局罚款，其分支行 2024 年多次因违规，被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局、证监会分局罚款、警示等。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,925,860.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,444,248.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,370,109.04

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国泰君安量化选股混合发起 A	23,570	15,218.89	132,951,662.65	37.06%	225,757,543.68	62.94%
国泰君安量化选股混合发起 C	4,524	44,649.85	21,853,007.73	10.82%	180,142,893.71	89.18%
国泰君安量化选股混合发起 D	106,434	3,499.73	337,009,990.55	90.47%	35,480,489.39	9.53%
合计	134,528	6,936.81	491,814,660.93	52.70%	441,380,926.78	47.30%

注：分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国泰君安量化选股混合发起 A	3,253,012.92	0.9069%
	国泰君安量化选股混合发起 C	1,630,305.80	0.8071%
	国泰君安量化选股混合发起 D	637,974.61	0.1713%
	合计	5,521,293.33	0.5917%

注：分类基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	国泰君安量化选股混合发起 A	>100
	国泰君安量化选股混合发起 C	>100
	国泰君安量化选股混合发起 D	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安量化选股混合发起 A	10~50
	国泰君安量化选股混合发起 C	>100
	国泰君安量化选股混合发起 D	0
	合计	>100

注：同时为基金管理人高级管理人员（含基金投资和研究部门负责人）和基金经理的，其持有份额总量的数量区间分别计算在内。

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	15,019,000.00	1.61%	15,019,000.00	1.61%	自基金合同生效日起不少于3年
基金管理人高级管理人员	990,678.85	0.11%	-	-	-
基金经理等人员	1,410,606.10	0.15%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	3,120,008.38	0.33%	-	-	-
合计	20,540,293.33	2.20%	15,019,000.00	1.61%	-

注：其他为公司普通员工持有份额，持有期限为不低于6个月。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安量化选股混合发起 A	国泰君安量化选股混合发起 C	国泰君安量化选股混合发起 D
基金合同生效日（2022 年 08 月 18 日）基金份额总额	10,009,990.10	5,010,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	1,006,563,351.58	716,584,193.27	831,115,687.85
本报告期基金总申购份额	485,517,051.93	139,543,611.99	635,194,855.31
减：本报告期基金总赎回份额	1,133,371,197.18	654,131,903.82	1,093,820,063.22
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	358,709,206.33	201,995,901.44	372,490,479.94

注：基金总申购份额含红利再投资及转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2024 年 2 月 28 日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告》，由叶明同志代为履行首席信息官职责，朱晓力同志不再担任公司首席信息官职务，生效日期为 2024 年 2 月 26 日。

2024 年 3 月 20 日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，陶耿同志兼任公司财务负责人，吕巍同志兼任公司首席风险官；叶明同志不再兼任财务负责人、首席风险官职务，生效日期为 2024 年 3 月 18 日。

2024 年 8 月 15 日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，吴楠同志和周诗宇同志不再担任公司副总裁职务，生效日期为 2024 年 8 月 13 日。

2024 年 9 月 7 日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，丁杰能同志担任公司副总裁职务，生效日期为 2024 年 9 月 5 日。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人于 2024-11-5 日改聘为其审计的会计师事务所。报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 50,000.00 元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为改聘日至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	2	41,572,175,199.85	100.00%	2,988,796.72	100.00%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	上海国泰君安证券资产管理有	上海证券报、中国证券报、证	2024-01-22

	限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	券时报、证券日报	
2	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金 2023 年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-01-22
3	上海国泰君安证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-02-28
4	上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-03-20
5	上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-03-20
6	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金 2023 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-03-29
7	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024-03-29
8	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-04-22
9	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024-04-22
10	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下部分产品在直销 APP 费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-05-27
11	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-06-28
12	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-06-28
13	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金（D 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-06-28
14	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-07-19
15	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年第 2	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024-07-19

	季度报告提示性公告		
16	上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-08-15
17	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-08-16
18	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-08-16
19	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金（D 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-08-16
20	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 1 号）	证监会指定网站、公司官网	2024-08-16
21	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金 2024 年中期报告	证监会指定网站、公司官网	2024-08-30
22	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年中期报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024-08-30
23	上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-09-07
24	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下部分产品在直销 APP 费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-10-11
25	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-10-25
26	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024-10-25
27	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在国泰君安资管 APP 开通基金转换业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2024-10-31
28	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-11-06
29	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下部分基金	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指	2024-11-07

	在国泰君安资管 APP 转换业务费用计算方法、转换业务适用范围和规则的公告	定网站、公司官网	
30	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下部分产品在直销 APP 费率优惠活动的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2024-11-25
31	在本报告期内刊登的其他公告	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金注册的批复；
- 2、《国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站
<http://www.gtjazg.com>。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

上海国泰君安证券资产管理有限公司

二〇二五年三月三十一日